

央视文化产业指数编制方案

为反映沪深北交易所文化产业上市公司的整体表现，向市场提供更丰富的指数化投资标的，编制央视文化产业指数。

一、代码与名称

指数名称：央视文化产业指数

指数简称：央视文化

英文名称：CCTV Culture Industry Index

英文简称：CCTV Culture

指数代码：399557

二、基日与基点

指数的基日为 2010 年 6 月 30 日，基点为 1000 点。

三、选样空间

满足下列条件的 A 股和红筹企业发行的存托凭证：

1. 非 ST、*ST 证券；
2. 科创板证券、北交所证券上市时间超过 1 年；其他证

- 券上市时间超过 6 个月；
3. 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；
 4. 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；
 5. 考察期内证券价格无异常波动；
 6. 公司业务范畴属于以下定义的产业领域：

文化产业	细分领域
新闻服务	新闻
出版印刷发行	图书；杂志；报纸；信息
广播电视电影	广播；电视；电影
网络新媒体	门户网站；搜索引擎；网络视频；网络游戏；电子商务； 互联网服务
广告	媒体广告
创意设计	园林设计；珠宝设计；工业设计
动漫游戏	动漫、游戏
专用软件	数字视频；通讯集成
旅游	景区及景区服务；主题公园；旅游演艺
非物质文化遗产	特色中药
会展节庆	会展、节庆
教育	教育培训
其他服务	艺术品经营服务；版权服务；商务代理服务
文化用品	文具；玩具；音像器材

四、选样方法

首先，计算入围选样空间证券在最近半年的日均总市值和日均成交金额；

其次，剔除选样空间内最近半年的日均成交金额排名位于后 10% 的证券；

然后，对选样空间剩余证券按照最近半年的日均总市值从高到低排序，选取前 50 名证券作为指数样本。

五、指数计算

指数采用派氏加权法，依据下列公式逐日连锁实时计算：

实时指数 = 上一交易日收市指数

$$\times \frac{\sum (\text{样本实时成交价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}{\sum (\text{样本上一交易日收市价} \times \text{样本权数} \times \text{权重调整因子})}$$

其中，样本权数调整方法参见指数计算与维护细则，权重调整因子见“七、样本权重调整”。

六、样本调整

1. 样本定期调整

指数样本实施半年度定期调整，于每年6月和12月的第二个星期五的下一个交易日实施。样本调整方案通常在实施前两周公布。

每次样本调整数量不超过样本总数的10%。排名在样本数70%范围内的非原样本按顺序优先入选，排名在样本数130%范围内的原样本按顺序优先保留。

在确定新入选成份后，在剩余证券中按日均总市值从高到低排序选取样本数量5%的证券作为备选样本。

2. 样本临时调整

样本出现终止上市时，将其从指数样本中剔除，选择备选

样本名单中排序最靠前的证券补足。

样本公司被实施风险警示，发生收购、合并、分拆情形的处理，同央视财经 50 指数。

七、样本权重调整

在指数计算中，对样本设置权重调整因子，包括样本调整系数与权重限制。首先，根据样本公司业务属性及文化产业相关主营收入占比，对样本设置两档权重调整系数：0.5 及 1；其次，对单只样本设置权重上限，使其权重不超过 10%。

权重调整因子每年调整 2 次，于样本定期调整时实施。在下一个定期调整日之前，权重调整因子一般固定不变。

当出现样本临时调整时，新进样本继承被剔除样本在调整前最后一个交易日的权重，据此计算新进样本的权重调整因子。